

RELATÓRIO DE ACOMPANHAMENTO DA CARTEIRA DE INVESTIMENTOS DA AMPREV
CONSOLIDAÇÃO DA CARTEIRA - JANEIRO 2014

ALOCACAO DOS RECURSOS DIVERSIFICACAO	E G M E N T O	VALOR R\$	RENTABILIDADE DO FUNDO		EM RELAÇÃO					
					META ATUARIAL		META GERENCIAL			
					INPC + 6%a.a.		CDI		IBOVESPA	
			NO MÊS	NO ANO 2014	NO MÊS	NO ANO 2014	NO MÊS	NO ANO 2014	NO MÊS	NO ANO 2014

PLANO FINANCEIRO

BANCO DO BRASIL S/A										
Carteira Administrada Banco do Brasil - LFT (POS)		11.772.794,98								
Carteira Administrada Banco do Brasil - NTN-B (POS)	R.F.	448.043.892,41	-3,24	-3,24	-290,24	-290,24	-386,82	-386,82		
Carteira Administrada Banco do Brasil - LTN (PRE)		912.355,79								
BB Previdenciário Renda Fixa IMA-B FI	R.F.	209.159,36	-2,51	-2,51	-224,96	-224,96	-299,82	-299,82		
BB Previdenciário Renda Fixa Perfil	R.F.	5.106.971,70	0,81	0,81	72,09	72,09	96,08	96,08		
BB RPPS Renda Fixa Fluxo FIC	R.F.	25.330.702,55	0,77	0,77	68,55	68,55	91,36	91,36		
FIDC da Cia de Saneamento Ambiental do D.F - CAESB	R.F.	9.255.949,17	-4,81	-4,81	-430,52	-430,52	-573,77	-573,77		
BB RPPS Renda Fixa Crédito Privado IPCA II	R.F.	15.404.471,25	-0,95	-0,95	-84,63	-84,63	-112,79	-112,79		
BB RPPS Renda Fixa Crédito Privado IPCA III	R.F.	7.486.952,00	-1,32	-1,32	-117,90	-117,90	-157,13	-157,13		
Brasil Ações Ibovespa Indexado FIC FI	R.V.	16.622.682,62	-7,91	-7,91	-708,08				-0,40	-0,40
Brasil Ações IBRX Indexado FIC FI	R.V.	7.303.183,37	-8,14	-8,14	-728,78	-728,78			-0,63	-0,63
BB Ações Consumo FIC FI	R.V.	3.480.115,73	-8,52	-8,52	-763,28	-763,28			-1,01	-1,01
BB Ações Cielo FI	R.V.	4.271.838,38	-2,26	-2,26	-202,71	-202,71				
TOTAL		555.201.069,31							5,25	5,25

CAIXA ECONÔMICA FEDERAL										
FI Caixa Brasil IPCA XI Renda Fixa Crédito Privado	R.F.	18.020.250,00	1,03	1,03	92,35	92,35	123,08	123,08		
FI Caixa Brasil IPCA XII Renda Fixa Crédito Privado	R.F.	18.220.112,50	1,21	1,21	108,27	108,27	144,30	144,30		
FI Caixa Brasil IPCA XIII Renda Fixa Crédito Privado	R.F.	17.724.937,50	1,32	1,32	118,36	118,36	157,75	157,75		
FI Caixa Brasil Referenciado DI Longo Prazo	R.F.	4.351.011,44	0,84	0,84	75,25	75,25	100,28	100,28		
FIC FI Caixa Novo Brasil IMA-B Renda Fixa LP	R.F.	74.548.266,24	-2,21	-2,21	-197,60	-197,60	-263,35	-263,35		
FI Caixa Brasil IMA-B 5 Títulos Públicos RF LP	R.F.	14.765.799,28	-0,80	-0,80	-71,57	-71,57	-95,38	-95,38		
FIDC da Companhia Estadual de Águas e Esgotos-CEDAE	R.F.	2.754.096,25	-1,23	-1,23	-110,09	-110,09	-146,72	-146,72		
Caixa FI em Ações Brasil IBX-50	R.V.	14.080.062,72	-7,93	-7,93	-709,66	-709,66			-0,42	-0,42
Caixa FIC Ações Valor Dividendos RPPS	R.V.	9.636.066,29	-6,71	-6,71	-600,36	-600,36			0,80	0,80
Caixa FI em Ações Caixa Small Caps Ativo	R.V.	841.057,24	-8,09	-8,09	-723,99	-723,99			-0,58	-0,58
FI Caixa Brasil IPCA V Multimercado Crédito Privado	M.M.	16.602.137,50	1,32	1,32	118,46	118,46	157,87	157,87		
FI Caixa Brasil IPCA VI Multimercado Crédito Privado	M.M.	6.104.936,00	1,35	1,35	120,74	120,74	160,91	160,91		
FI Caixa Brasil IPCA VIII Multimercado Crédito Privado	M.M.	5.461.200,22	1,09	1,09	97,69	97,69	130,20	130,20		
TOTAL		203.109.933,18								

BANCO BRADESCO S/A										
Bradesco FI Renda Fixa IMA-B	R.F.	158.262.587,03	-2,50	-2,50	-224,05	-224,05	-298,60	-298,60		
Bradesco FI Renda Fixa IMA-Geral	R.F.	88.882.079,62	-0,84	-0,84	-75,47	-75,47	-100,59	-100,59		
Bradesco FI Renda Fixa IMA-B 5+	R.F.	1.188.723,15	-3,80	-3,80	-340,25	-340,25	-453,46	-453,46		
Bradesco FI em Ações Infra-Estrutura	R.V.	15.236.522,24	-8,48	-8,48	-759,09	-759,09			-0,97	-0,97
Bradesco FI em Ações Dividendos	R.V.	1.973.393,16	-7,47	-7,47	-668,76	-668,76			0,04	0,04
Bradesco FI em Ações Small Cap Plus	R.V.	910.349,67	-8,97	-8,97	-802,80	-802,80			-1,46	-1,46
Bradesco FI Multimercado Plus I	M.M.	1.288.094,06	0,80	0,80	72,04	72,04	96,0	96,01		
TOTAL		267.741.748,93								

ITAU UNIBANCO S/A										
Itaú Institucional Renda Fixa Inflação FIC FI	R.F.	81.512.890,97	-2,57	-2,57	-230,31	-230,31	-306,94	-306,94		
Itaú Institucional RF Inflação 5 FIC FI	R.F.	12.798.247,74	-0,81	-0,81	-72,44	-72,44	-96,55	-96,55		
Itaú RPI Ações Ibovespa Index FIC FI em Ações	R.V.	34.595.132,93	-7,23	-7,23	-647,04	-647,04			0,28	0,28
FIC FIP Kinea Private Equity II	R.V.	2.493.302,55	3,93	3,93	351,52	351,52			11,44	11,44
Itaú Ações Consumo FI	R.V.	3.509.154,03	-8,37	-8,37	-749,57	-749,57			-0,86	-0,86
Itaú Institucional Multimercado Juros e Moedas	M.M.	3.997.904,46	0,81	0,81	72,87	72,87	97,1	97,12		
TOTAL		138.906.632,68								

BANCO HSBC BANK BRASIL S/A										
Hsbc FI Renda Fixa Regimes de Previdência Ativo	R.F.	100.955.097,30	-1,02	-1,02	-91,73	-91,73	-122,25	-122,25		
Hsbc FI em Ações Ibovespa Top	R.V.	14.006.258,09	-7,63	-7,63	-683,24	-683,24			-0,12	-0,12
Hsbc FI Ações Ibovespa Valuation	R.V.	3.230.485,09	-7,97	-7,97	-713,63	-713,63			-0,46	-0,46
Hsbc FI de Ações Small Caps	R.V.	823.431,42	-9,98	-9,98	-893,37	-893,37			-2,47	-2,47
TOTAL		119.015.271,90								

BANCO SANTANDER S/A										
Santander FIC FI IMA-B Títulos Públicos Renda Fixa	R.F.	59.276.948,30	-2,79	-2,79	-249,68	-249,68	-332,76	-332,76		
Santander FIC FI IMA-B Institucional Títulos Públicos RF LP	R.F.	8.090.464,88	-2,77	-2,77	-248,02	-248,02	-330,55	-330,55		
Santander FIC FI Dividendos VIP Ações	R.V.	1.444.406,76	-7,21	-7,21	-645,54	-645,54			0,30	0,30
TOTAL		68.811.819,94								

SCHRODERS INVESTMENT										
Schroder FI em Ações IBRX-50	R.V.	13.986.414,36	-7,39	-7,39	-661,86	-661,86			0,12	0,12
TOTAL		13.986.414,36								

GWI CONSULT, PARTICIP. E SERV. LTDA.										
GWI Classic Fundo de Investimento em Ações	R.V.	437.396,84	-12,78	-12,78	-1.144,34	-1.144,34			-5,27	-5,27
TOTAL		437.396,84								

BANCO BNP PARIBAS BRASIL S.A.										
BNP Paribas Grand Prix Fundo de Investimento Ações	R.V.	2.005.493,13	-6,12	-6,12	-547,65	-547,65			1,39	1,39
TOTAL		2.005.493,13								

BANCO CRUZEIRO DO SUL S/A										
FIDC Aberto CPP540 RPPS	R.F.	12.011.419,11	1,38	1,38	123,54	123,54	164,64	164,64		
TOTAL		12.011.419,11								

BANCO BTG PACTUAL										
BTG Pactual FI RF IMA B	R.F.	19.950.428,11	-2,67	-2,67	-238,85	-238,85	-318,33	-318,33		
BTG Pactual IPCA FI Renda Fixa	R.F.	13.936.931,81	-0,75	-0,75	-66,96	-66,96	-89,24	-89,24		
BTG Pactual Dividendos FI de Ações	R.V.	23.072.215,16	-5,70	-5,70	-510,55	-510,55			1,81	1,81
TOTAL		56.959.575,08								

GERAÇÃO FUTURO CORRETORA DE VALORES S.A.										
Geração Futuro Dividendos FIA	R.V.	1.485.040,17	-4,90	-4,90	-438,66	-438,66			2,61	2,61

TOTAL		1.485.040,17									
--------------	--	---------------------	--	--	--	--	--	--	--	--	--

QUELUZ GESTAO DE RECURSOS FINANCEIROS LTDA.

Queluz Valor Fundo de Investimento em Ações	R.V.	1.579.981,27	-7,08	-7,08	-633,81	-633,81			0,43	0,43
TOTAL		1.579.981,27								

PATRIA INVESTIMENTOS LTDA.

Patria Special Opportunities I FIQ FI	R.V.	3.104.162,93	-0,12	-0,12	-11,11	-11,11			7,39	7,39
TOTAL		3.104.162,93								

QUEST INVESTIMENTOS

Quest Small Fiq Fia	R.V.	3.575.834,27	-9,15	-9,15	-819,68	-819,68			-1,64	-1,64
TOTAL		3.575.834,27								

TOTAL APLICADO DO PLANO FINANCEIRO
1.447.931.793,10
DISPONIBILIDADE DOS FUNDOS EM 31/01/2014
PLANO PREVIDENCIARIO
CAIXA ECONOMICA FEDERAL

Carteira Administrada Caixa Economica - NTN-B (POS)	R.F.	141.926.813,53	-2,56	-2,56	-229,22	-229,22	-305,49	-305,49		
FIC FI Caixa Novo Brasil IMA-B Renda Fixa LP	R.F.	72.431.058,70	-2,21	-2,21	-197,60	-197,60	-263,35	-263,35		
FI Caixa Brasil IMA-B 5 Títulos Públicos RF LP	R.F.	4.079.650,34	-0,80	-0,80	-71,57	-71,57	-95,38	-95,38		
FI Caixa Brasil IPCA XV Renda Fixa Crédito Privado	R.F.	5.931.298,19	1,25	1,25	112,31	112,31	149,68	149,68		
FI Caixa Brasil Referenciado DI Longo Prazo	R.F.	7.139.341,98	0,84	0,84	75,25	75,25	100,28	100,28		
Caixa FI em Ações Caixa Small Caps Ativo	R.V.	450.848,73	-8,09	-8,09	-723,99	-723,99			-0,58	-0,58
FI Caixa Brasil IPCA VI Multimercado Crédito Privado	M.M.	5.858.431,33	1,35	1,35	120,74	120,74	160,91	160,91		
TOTAL		237.817.442,80								

BANCO DO BRASIL S/A

BB Previdenciário Renda Fixa IMA-B FI	R.F.	22.506.495,62	-2,51	-2,51	-224,96	-224,96	-299,82	-299,82		
BB RPPS Renda Fixa Fluxo FIC	R.F.	381.814,60	0,77	0,77	68,55	68,55	91,36	91,36		
BB RPPS Renda Fixa Crédito Privado IPCA III	R.F.	4.518.235,95	-1,32	-1,32	-117,90	-117,90	-157,13	-157,13		
TOTAL		27.406.546,17								

GWJ CONSULTORIA, PARTICIPAÇÕES E SERVIÇOS LTDA.

GWJ Classic Fundo de Investimento em Ações	R.V.	1.262.108,54	-12,78	-12,78	-1.144,34	-1.144,34			-5,27	-5,27
TOTAL		1.262.108,54								

BANCO BTG PACTUAL

BTG Pactual IPCA FI Renda Fixa	R.F.	14.830.650,13	-0,75	-0,75	-66,96	-66,96	-89,24	-89,24		
BTG Pactual FI RF IMA B	R.F.	3.299.932,52	-2,67	-2,67	-238,85	-238,85	-318,33	-318,33		
TOTAL		18.130.582,65								

BANCO BRADESCO S/A

Bradesco FI Renda Fixa IMA-B	R.F.	10.969.935,54	-2,50	-2,50	-224,05	-224,05	-298,60	-298,60		
Bradesco FI Renda Fixa IMA-Geral	R.F.	5.145.233,86	-0,84	-0,84	-75,47	-75,47	-100,59	-100,59		
Bradesco FI Renda Fixa IMA-B 5+	R.F.	577.913,32	-3,80	-3,80	-340,25	-340,25	-453,46	-453,46		
Bradesco FI em Ações Dividendos	R.V.	681.522,83	-7,47	-7,47	-668,76	-668,76			0,04	0,04
Bradesco FI em Ações Small Cap Plus	R.V.	486.189,29	-8,97	-8,97	-802,80	-802,80			-1,46	-1,46
TOTAL		17.860.794,84								

ITAU UNIBANCO S/A

Itaú Institucional Renda Fixa Inflação FIC FI	R.F.	1.729.192,45	-2,57	-2,57	-230,31	-230,31	-306,94	-306,94		
Itaú Institucional RF Inflação 5 FIC FI	R.F.	4.060.377,08	-0,81	-0,81	-72,44	-72,44	-96,55	-96,55		
TOTAL		5.789.569,53								

BANCO SANTANDER S/A

Santander FIC FI IMA-B Títulos Públicos Renda Fixa	R.F.	2.666.914,18	-2,79	-2,79	-249,68	-249,68	-332,76	-332,76		
Santander FIC FI IMA-B Institucional Títulos Públicos RF LP	R.F.	196.714,16	-2,77	-2,77	-248,02	-248,02	-330,55	-330,55		
Santander FIC FI Dividendos VIP Ações	R.V.	667.693,81	-7,21	-7,21	-645,54	-645,54			0,30	0,30
TOTAL		3.531.322,15								

TOTAL APLICADO DO PLANO PREVIDENCIÁRIO
311.798.366,68
DISPONIBILIDADE DOS FUNDOS EM 31/01/2014
TOTAL GERAL APLICADO - (R\$)
1.759.730.159,78
PLANO FINANCEIRO (+) PLANO PREVIDENCIÁRIO
RESUMO DA DISTRIBUIÇÃO POR SEGMENTO DE INVESTIMENTO - EM 31/01/2014
PLANO FINANCEIRO

DESCRIÇÃO	VALOR (R\$)	PARTICIP. (%)	RENDIMENTO (R\$)
CARTEIRAS DE TÍTULOS PÚBLICOS FEDERAIS	460.729.043,18	31,79%	-15.392.663,03
FUNDOS DE RENDA FIXA	770.044.497,26	53,13%	-11.664.861,75
FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL	183.703.980,42	12,67%	-14.070.906,74
FUNDOS RENDA VARIÁVEL MULTIMERCADO	33.454.272,24	2,31%	372.568,30
SALDO EM CONTAS CORRENTES	1.498.226,62	0,10%	
TOTALS	1.449.430.019,72	100,00%	-40.755.863,22

PLANO PREVIDENCIARIO

DESCRIÇÃO	VALOR (R\$)	PARTICIP. (%)	RENDIMENTO (R\$)
CARTEIRAS DE TÍTULOS PÚBLICOS FEDERAIS	141.926.813,53	45,52%	-4.456.431,50
FUNDOS DE RENDA FIXA	160.464.758,62	51,46%	-2.930.911,21
FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL	3.548.363,20	1,14%	-379.373,85
FUNDOS RENDA VARIÁVEL MULTIMERCADO	5.858.431,33	1,88%	77.947,03
SALDO EM CONTAS CORRENTES	16.561,76	0,01%	
TOTALS	311.814.928,44	100,00%	-7.688.769,53

**CONSOLIDAÇÃO DOS PLANO NA DISTRIBUIÇÃO POR SEGMENTO - JANEIRO DE 2014
PLANO FINANCEIRO (+) PLANO PREVIDENCIÁRIO**

DESCRIÇÃO	VALOR R\$	%	RENDIMENTO TOTAL NO MÊS (R\$)
CARTEIRA DE TÍTULOS PÚBLICOS FEDERAIS	602.655.856,71	34,22%	-19.849.094,53
FUNDOS DE RENDA FIXA	930.509.255,88	52,83%	-14.595.772,96
FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL	187.252.343,62	10,63%	-14.450.280,59
FUNDOS RENDA VARIÁVEL MULTIMERCADO	39.312.703,57	2,23%	450.515,33
SALDO EM CONTAS CORRENTES	1.514.788,38	0,09%	
TOTALS	1.761.244.948,16	100,00%	-48.444.632,75

SIGLAS

R.F. - Renda Fixa
R.V. - Renda Variável
M.M. - Multimercado
CDI - Certificado de Depósito Interfinanceiro
IBOVESPA - Índice da Bolsa de Valores Est. São Paulo

DISPONIBILIDADE POR INSTITUIÇÃO FINANCEIRA - JANEIRO DE 2014					
INSTITUIÇÃO	EM FUNDO	EM CONTA CORRENTE	TOTAL BANCO	% POR INSTITUIÇÃO	QTDE. FUNDOS
BANCO DO BRASIL S/A	582.607.615,48	1.505.007,34	584.112.622,82	33,16%	11
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	440.927.375,98	4.932,46	440.932.308,44	25,04%	15
BANCO BRADESCO S/A	285.602.543,77	0,00	285.602.543,77	16,22%	7
ITAU UNIBANCO S/A	144.696.202,21	844,13	144.697.046,34	8,22%	6
BANCO HSBC BANK BRASIL S/A	119.015.271,90	4.004,45	119.019.276,35	6,76%	4
BANCO SANTANDER S/A	72.343.142,09	0,00	72.343.142,09	4,11%	3
SCHRODERS INVESTIMENT	13.986.414,36	0,00	13.986.414,36	0,79%	1
GWJ CONSULT, PARTICIP. E SERV. LTDA.	1.699.505,38	0,00	1.699.505,38	0,10%	1
BANCO BNP PARIBAS BRASIL S.A.	2.005.493,13	0,00	2.005.493,13	0,11%	1
BANCO CRUZEIRO DO SUL S/A	12.011.419,11	0,00	12.011.419,11	0,68%	1
BANCO BTG PACTUAL	75.090.157,73	0,00	75.090.157,73	4,26%	3
GERAÇÃO FUTURO CORRETORA DE VALORES S.A.	1.485.040,17	0,00	1.485.040,17	0,08%	1
QUELUZ GESTÃO DE RECURSOS FINANCEIROS LTDA.	1.579.981,27	0,00	1.579.981,27	0,09%	1
PÁTRIA INVESTIMENTOS LTDA	3.104.162,93	0,00	3.104.162,93	0,18%	1
QUEST SMALL FIO FIA	3.575.834,27	0,00	3.575.834,27	0,20%	1
TOTAIS	1.759.730.159,78	1.514.788,38	1.761.244.948,16	100,00%	57

Em janeiro de 2014, os índices para atingimento das metas, atuarial e gerencial, são os seguintes:

SEGMENTO	META ATUARIAL (%)			META GERENCIAL (%)		
	ÍNDICE	JAN/14	2014	ÍNDICE	JAN/14	2014
TÍTULOS PÚBLICOS FEDERAIS	INPC(IBGE) + 6% a.a.	1,12	1,12	C.D.I.	0,84	0,84
RENTA FIXA	INPC(IBGE) + 6% a.a.	1,12	1,12	C.D.I.	0,84	0,84
RENTA VARIÁVEL	INPC(IBGE) + 6% a.a.	1,12	1,12	IBOVESPA	-7,51	-7,51
RENTA VARIÁVEL - MULTIMERCADO	INPC(IBGE) + 6% a.a.	1,12	1,12	C.D.I.	0,84	0,84

A Amapá Previdência, seguindo as diretrizes estabelecidas em sua Política de Investimentos e a Resolução nº 3922/2010 do Conselho Monetário Nacional, aplicou seus recursos de maneira diversificada em janeiro de 2014, distribuídos em 02 (duas) Carteira de Administradas de Títulos Públicos Federais e 55 (cinquenta e cinco) Fundos de Investimentos, sendo estes últimos distribuídos em 25 (vinte e cinco) fundos de renda fixa, 25 (vinte e cinco) fundos de renda variável e 05 (quatro) fundos multimercado.